

# PROVISIONNEMENT STOCHASTIQUE EN ASSURANCE NON-VIE

2 jours

Fiche d'inscription  
sur [www.caritat.fr](http://www.caritat.fr)

Assurances dommages



## À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires et collaborateurs des services techniques et comptables des mutuelles, des institutions de prévoyance, des sociétés d'assurance et de réassurance, de l'audit et du conseil.

## Pour obtenir quoi ?

Renforcer ses compétences techniques par un exposé complet des méthodes stochastiques de calcul de la provision pour sinistres à payer, dans la perspective des évolutions 'Solvency 2', modèles internes, normes IFRS/IAS...

## Comment ?

Les apports théoriques sont complétés, tout au long de la formation, soit par des travaux pratiques réalisés sous Excel par les participants, soit par des illustrations concrètes de mise en œuvre sous 'R' présentées par le formateur.

## Quels sont les pré-requis ?

Bonnes notions de base en statistiques.

Chaque participant se munira d'un ordinateur portable pour les travaux pratiques.

## Qui anime cette formation ?

Arthur CHARPENTIER, Maître de conférences à l'Université de Rennes, membre agrégé de l'Institut des Actuaire.



Jean-Marie NESSI, administrateur et ancien dirigeant d'organismes d'assurance et de réassurance, membre agrégé de l'Institut des Actuaire.



## Qu'allez-vous apprendre ?

### Introduction aux techniques de provisionnement : vers une classification des modèles

### L'approche Chain-Ladder et quelques modèles déterministes

- L'approche Chain-Ladder
- Le problème de l'inflation dans les triangles

### Méthodes récursives model-free : l'approche de Mack

- Erreur par année de survenance
- Erreur par triangle
- Impact sur les boni-mali

### Modèles factoriels

- Quelles variables explicatives ?
- Régression lognormale
- Régression poissonnienne
- Modélisation GLM
- Uniformisation par les modèles Tweedie
- Introduction aux modèles GAM

### Méthodes de simulation

- Le bootstrap, ou simulation non paramétrique
- Les simulations paramétriques
- Calculs de VaR ou de TVaR

### Approche bayésienne

- Introduire un avis d'expert
- L'approche bayésienne du provisionnement

### La difficulté du choix de modèle

### Agréger les triangles

### La problématique du provisionnement dans l'optique Solvabilité 2

## La formation en pratique...

### Quand et où ?

**28 et 29 juin 2010**

9 h - 12 h 30 et 14 h - 17 h 30  
Hôtel Bedford, Paris 8°

### Combien ça coûte ?

1 950 € HT + TVA 19,60%, soit 2 332,20 € TTC.  
Les frais de participation couvrent les deux journées de formation, la documentation complète, les deux déjeuners et les pauses café.

### Où vous loger ?

Si vous venez de province ou de l'étranger, pour toute réservation d'hôtel, contactez notre partenaire : Elysées West Hôtel - 01 47 75 92 90 - [www.ewh.com](http://www.ewh.com).  
Demandez le tarif Caritat.

### Contact :

01 44 51 04 04

## Qu'en disent les stagiaires ?

« Programme intéressant et bien présenté. Tout était systématiquement mis en pratique, ce qui est appréciable. »  
*Julie S., actuaire, SCOR*

« Formateur très pédagogue et très agréable. »  
*David L., chargé d'analyse statistique, MAAF*

« Forme et contenu des exposés très bien. Documents bien préparés. »  
*Przemyslaw S., consultant, ALTIA*